공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	10	0	10	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

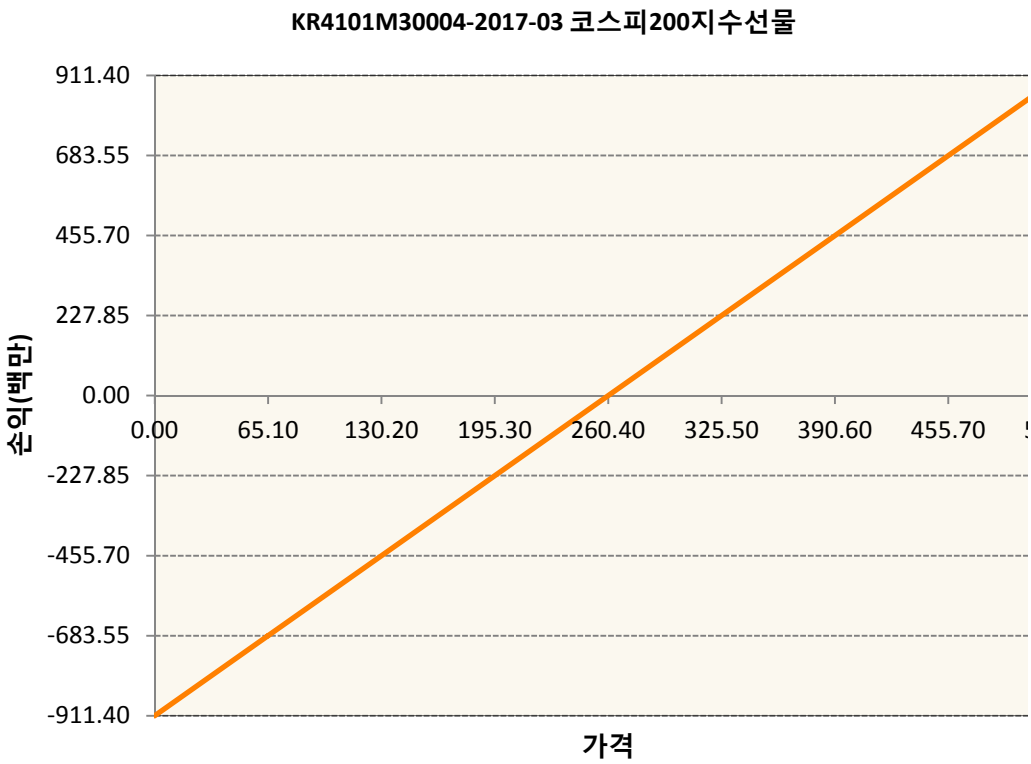
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	911	0	911	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

55

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

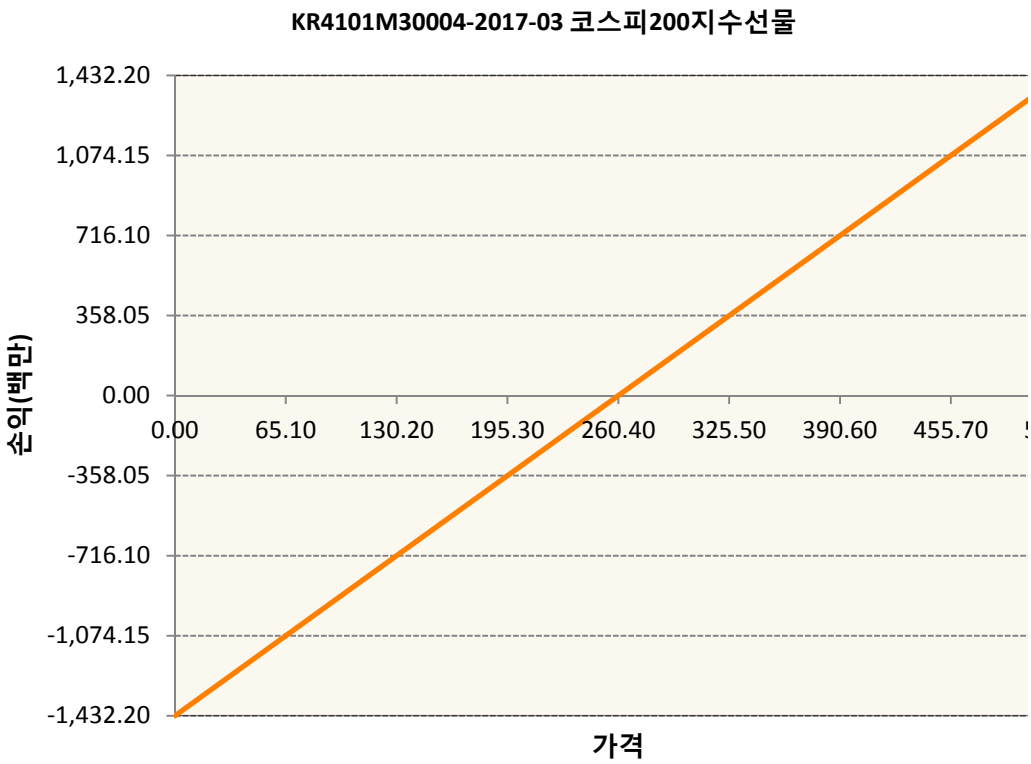
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,432	0	1,432	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

86

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

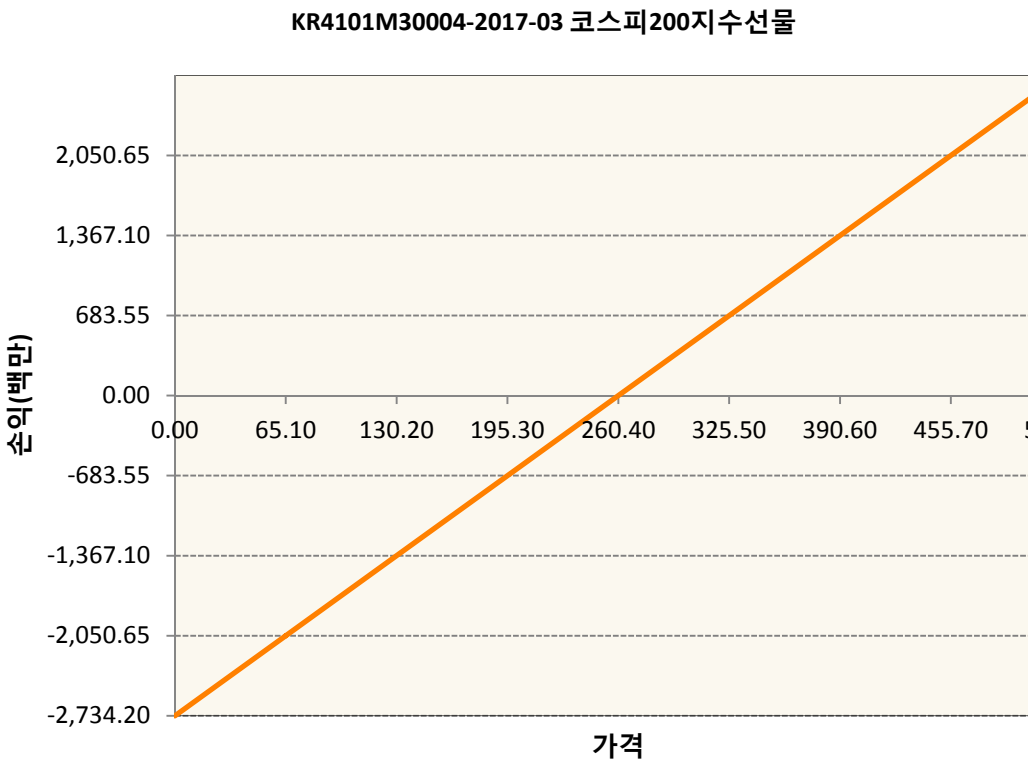
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,734	0	2,734	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218
-5.33%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	145	145	145	145	145	145	145
8.00%	218	218	218	218	218	218	218

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

164

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	11,013	0	11,013	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S161122	909

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

712

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

688

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

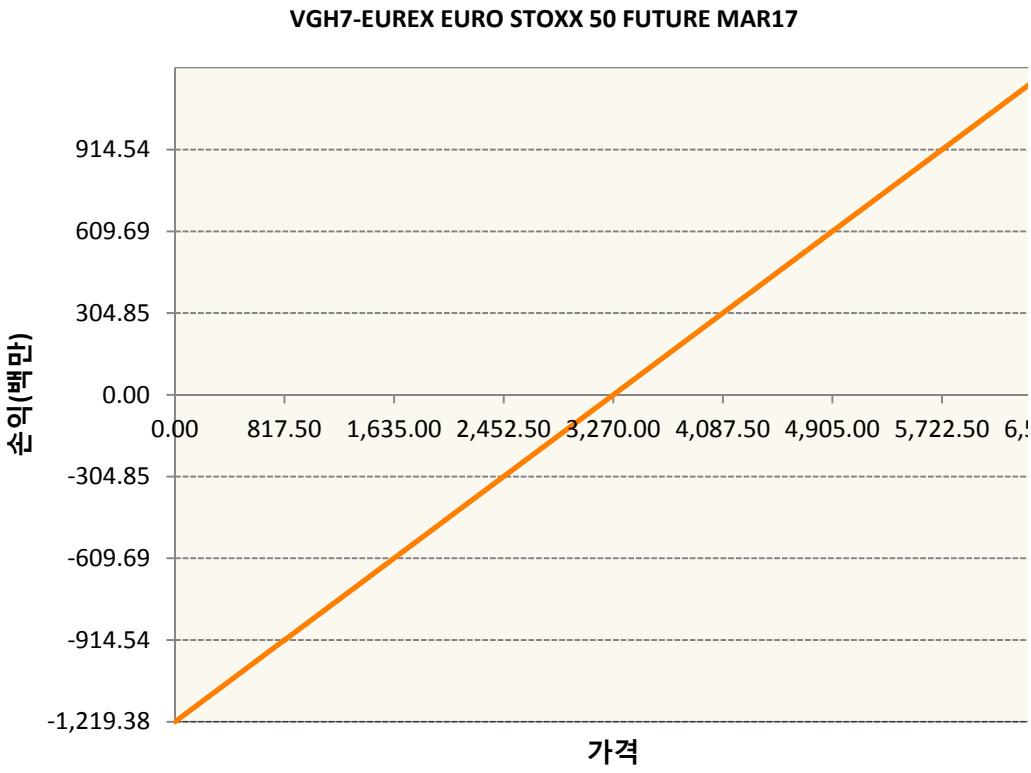
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,219	0	1,219	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

113

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

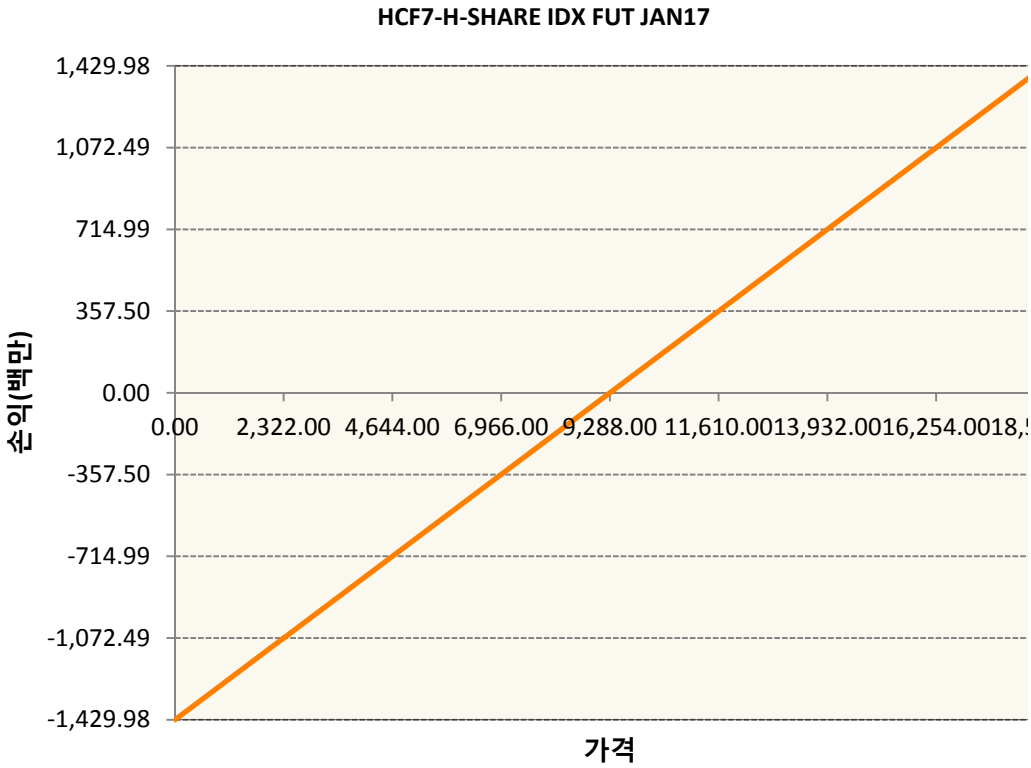
차이나인덱스모(주식-파생형)

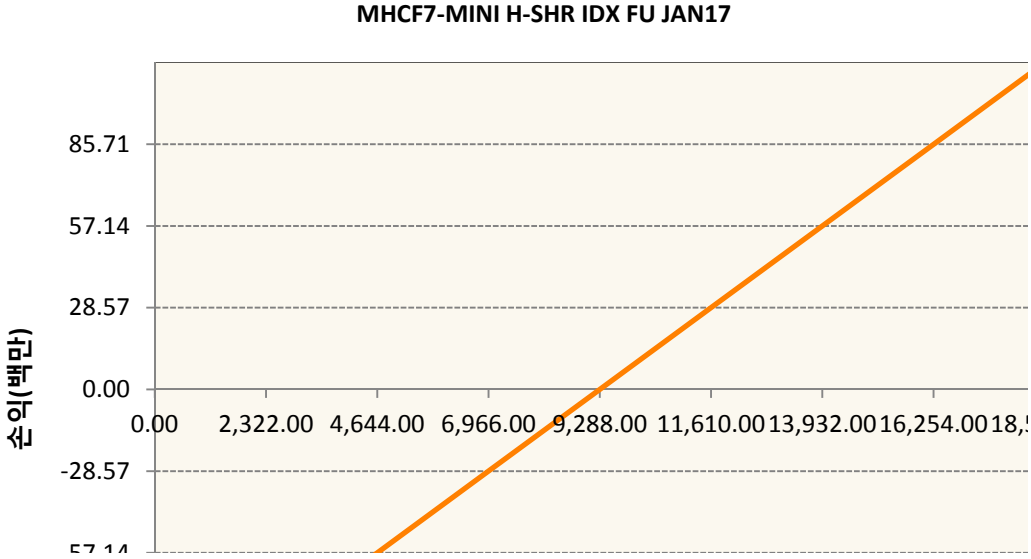
1. 계약금액

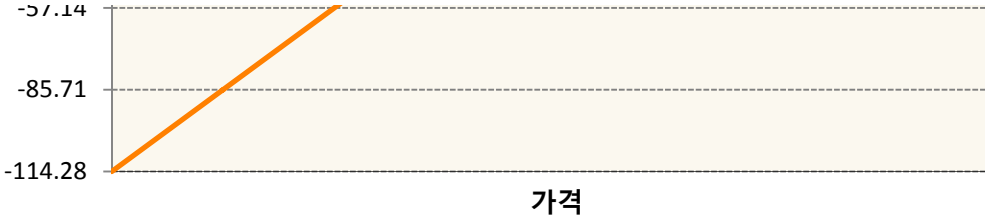
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,544	0	1,544	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	114
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

152

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

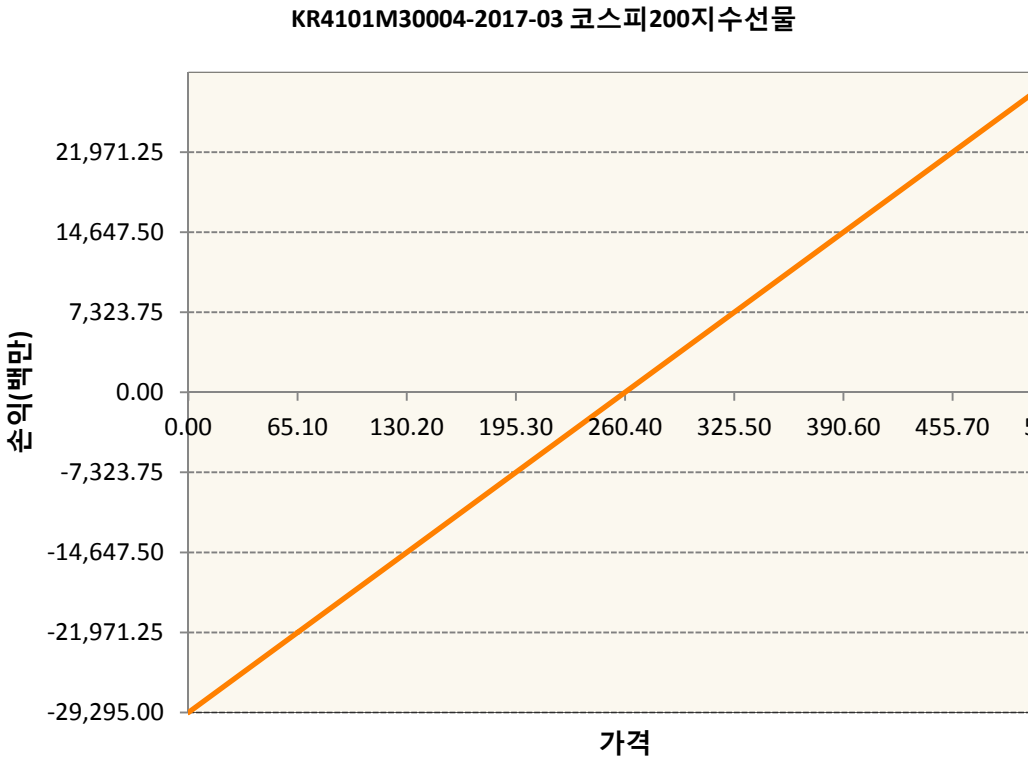
커버드콜(주식혼합-파생형)

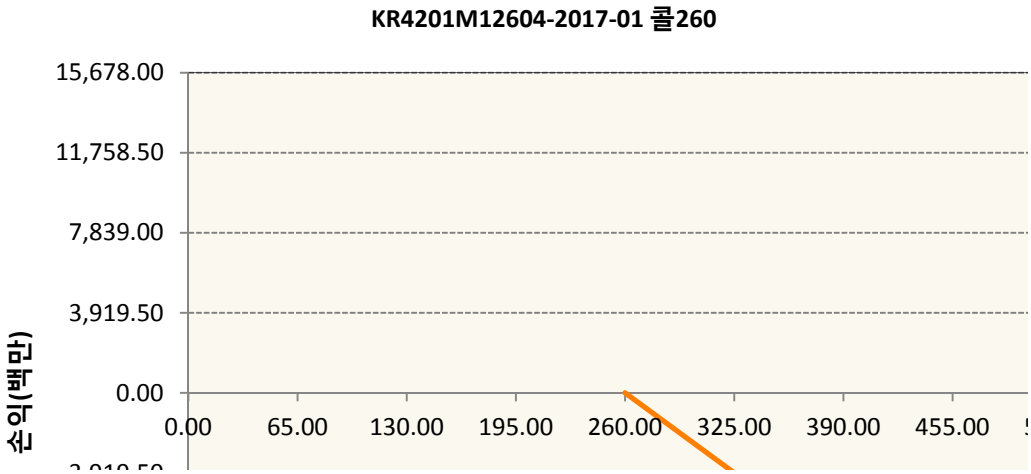
1. 계약금액

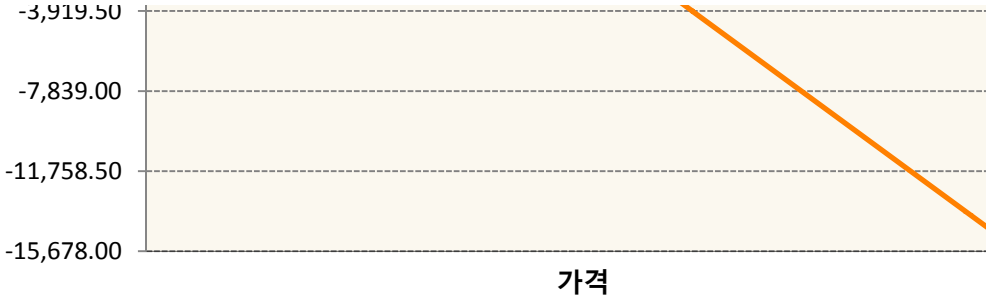
(단위:백만원)

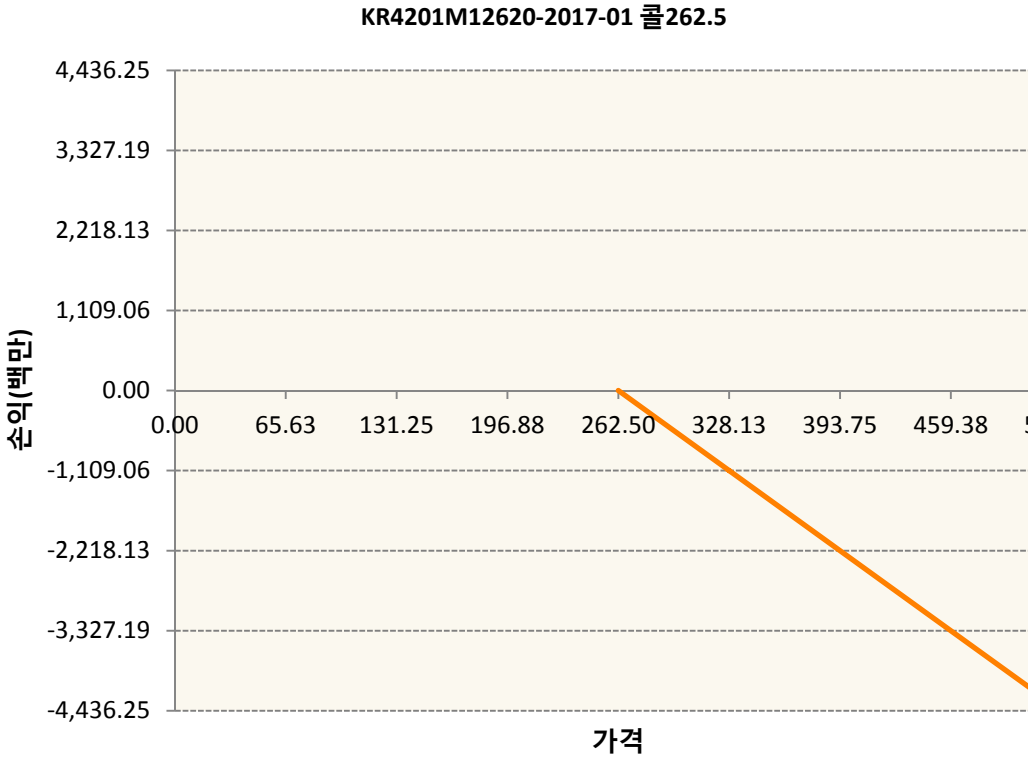
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	263	-263	장내
누계	유가증권	선물	29,295	0	29,295	장내
누계	유가증권	옵션	0	20,114	-20,114	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,337
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,337	-2,337	-2,337	-2,337	-2,337	-2,337	-2,337
-5.33%	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558
-2.67%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	779	779	779	779	779	779	779
5.33%	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558
8.00%	2,337	2,337	2,337	2,337	2,337	2,337	2,337
KR4201M12(2017-01 콜260							5,526
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	645	645	645	645	645	645	644
-5.33%	645	644	643	642	639	634	628
-2.67%	622	606	587	563	537	507	474
0%	172	115	57	0	-57	-115	-172
2.67%	-1,387	-1,408	-1,433	-1,461	-1,493	-1,528	-1,566
5.33%	-3,437	-3,438	-3,440	-3,443	-3,449	-3,456	-3,466
8.00%	-5,524	-5,524	-5,524	-5,524	-5,524	-5,525	-5,526
	KR4201M12(	2017-01 콜262.5					1,421

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	98	98	98	98	98	98
-5.33%	98	98	98	98	98	97	97
-2.67%	97	95	93	90	86	81	75
0%	41	28	14	0	-15	-29	-44
2.67%	-284	-295	-307	-320	-333	-346	-360
5.33%	-835	-836	-838	-841	-844	-848	-853
8.00%	-1,419	-1,419	-1,419	-1,420	-1,420	-1,420	-1,421

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

10,367

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

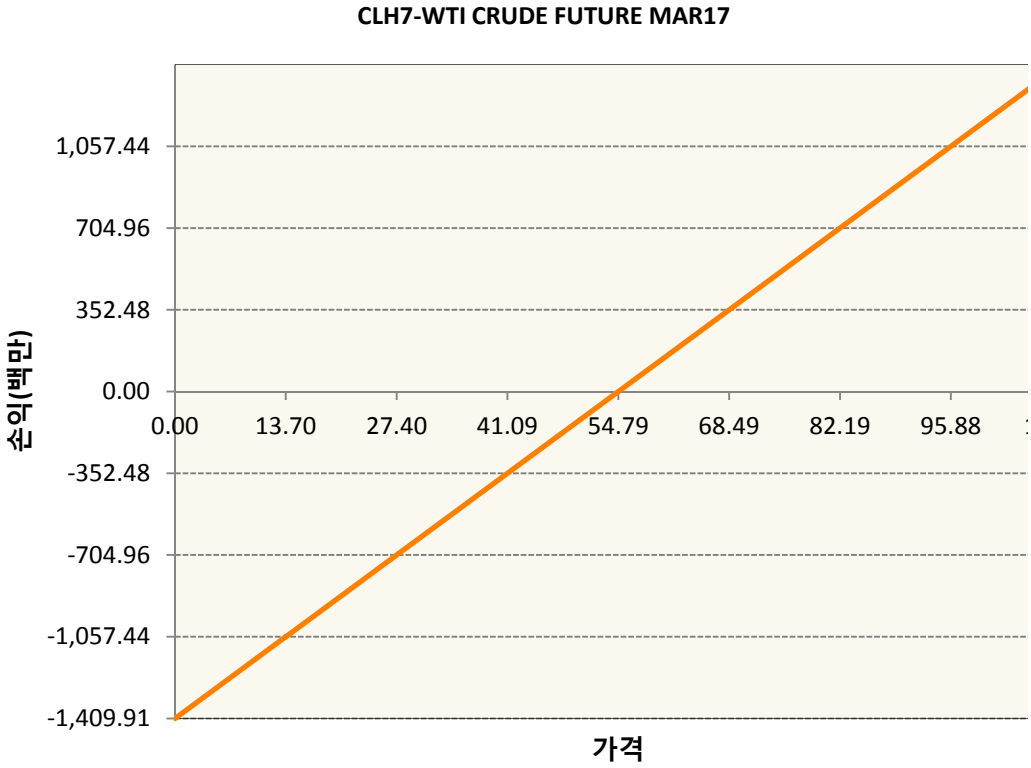
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

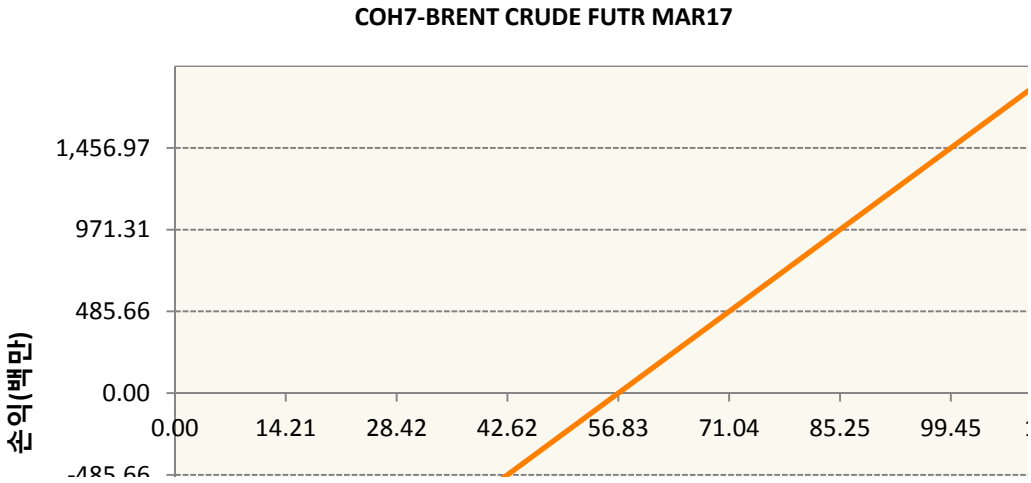
1. 계약금액

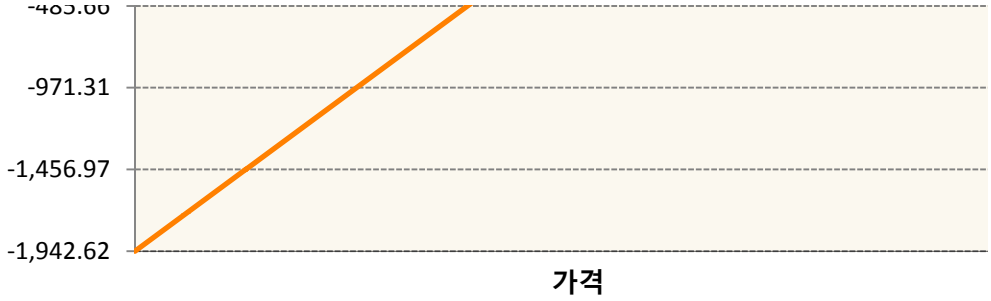
(단위:백만원)

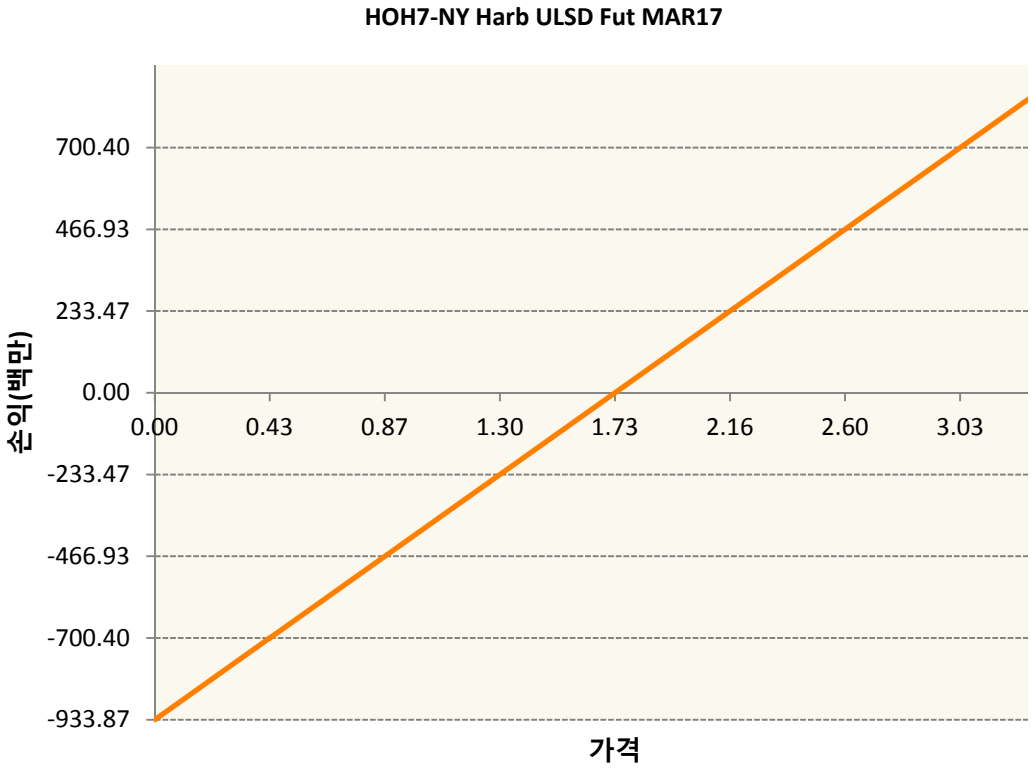
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,410	0	1,410	
누계	유가증권	선물	5,616	0	5,616	

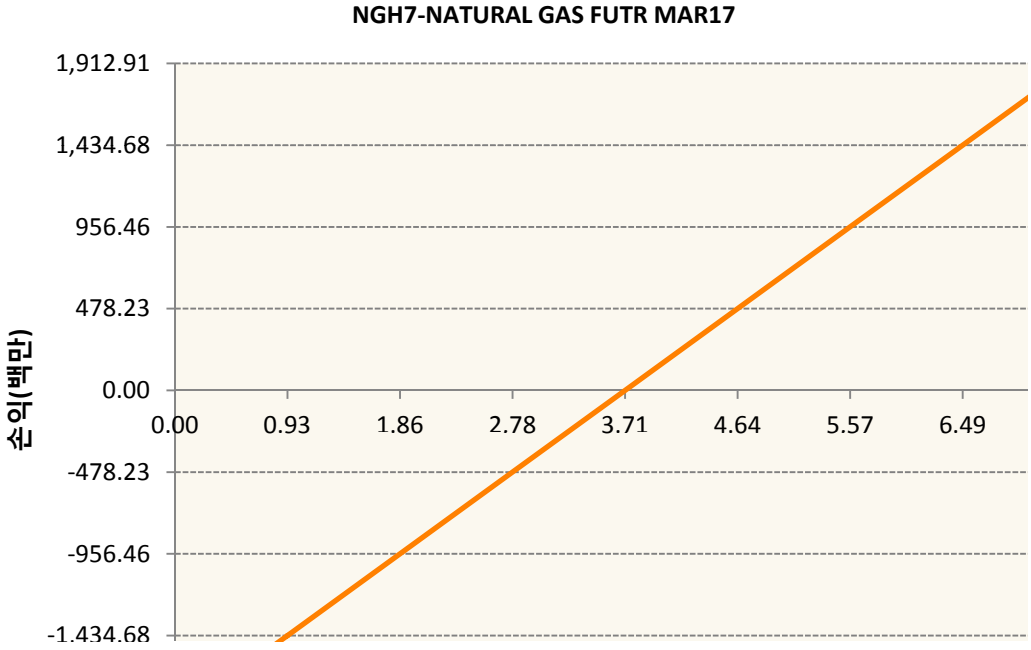
2. 만기시점의 손익구조

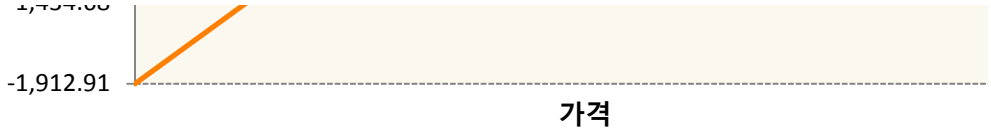


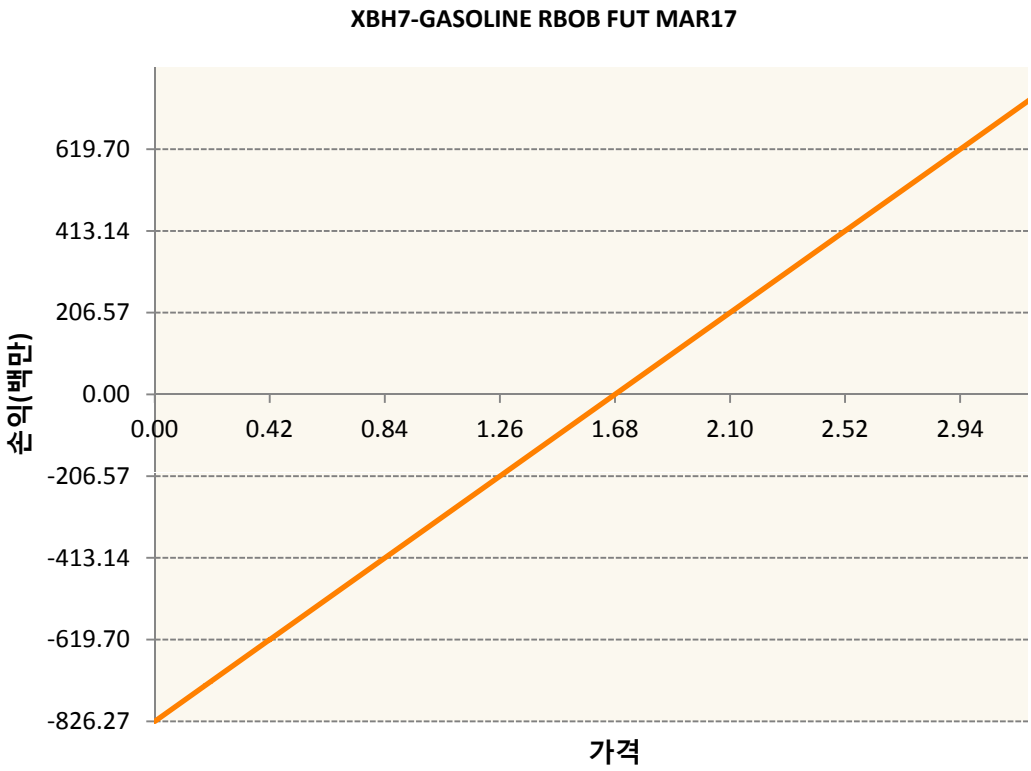



-971.31
-1,456.97
-1,942.62
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
700.40
466.93
233.47
0.00
-233.47
-466.93
-700.40
-933.87
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
손익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,912.91
1,434.68
956.46
478.23
0.00
-478.23
-956.46
-1,434.68
0.00
0.93
1.86
2.78
3.71
4.64
5.57
6.49
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	113
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	155
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	75
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	153
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	66

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

1,279

공시일	2016-12-29
기준일	2016-12-28

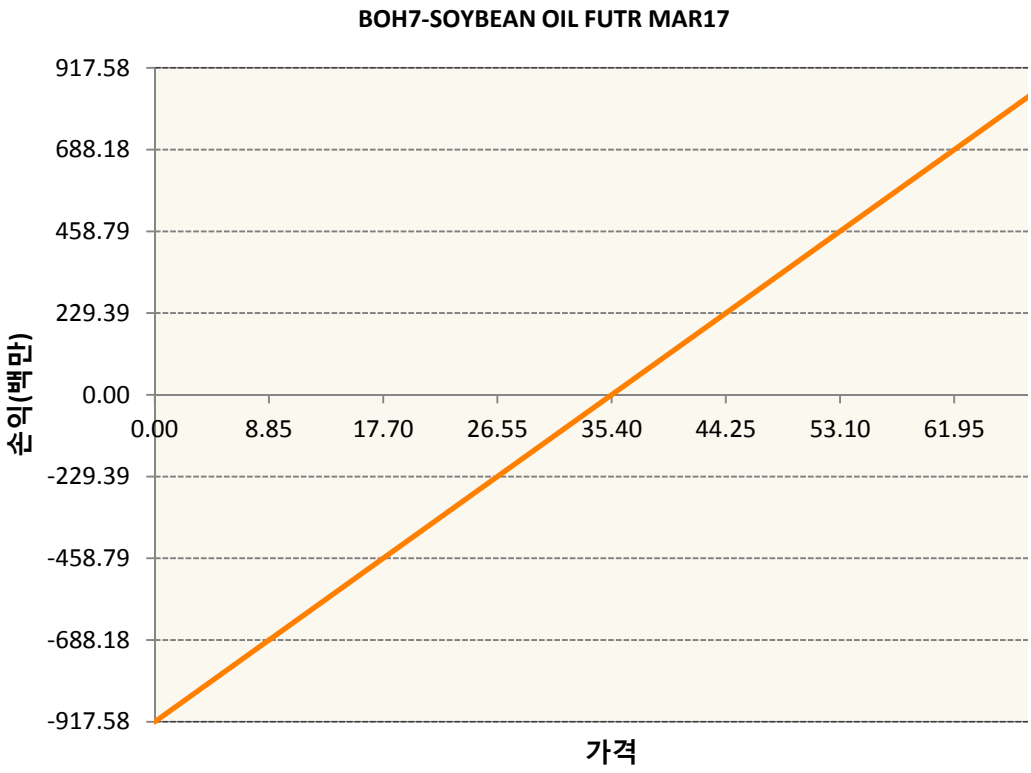
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

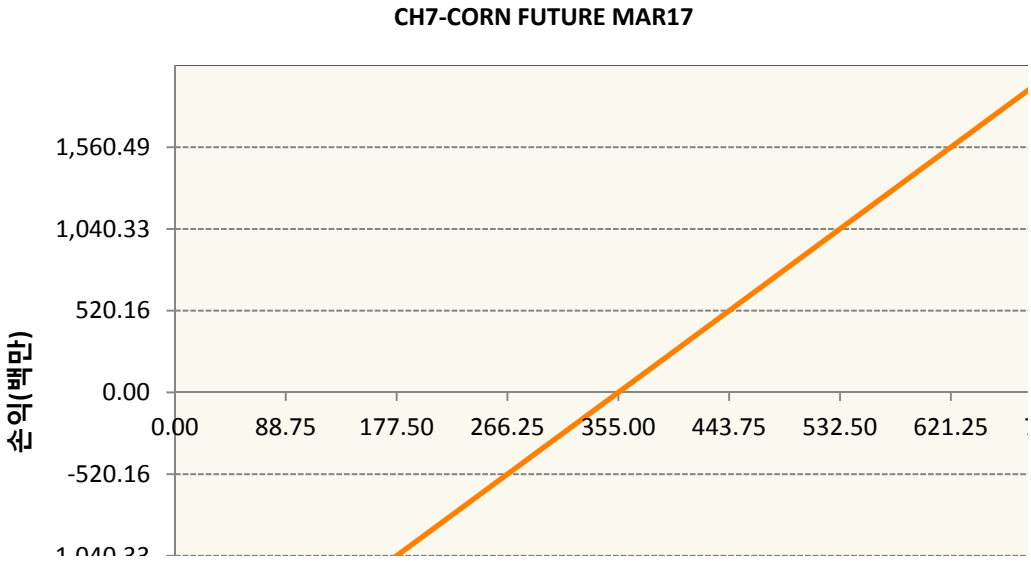
1. 계약금액

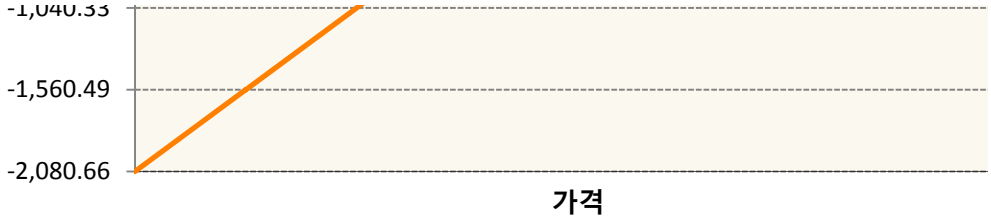
(단위:백만원)

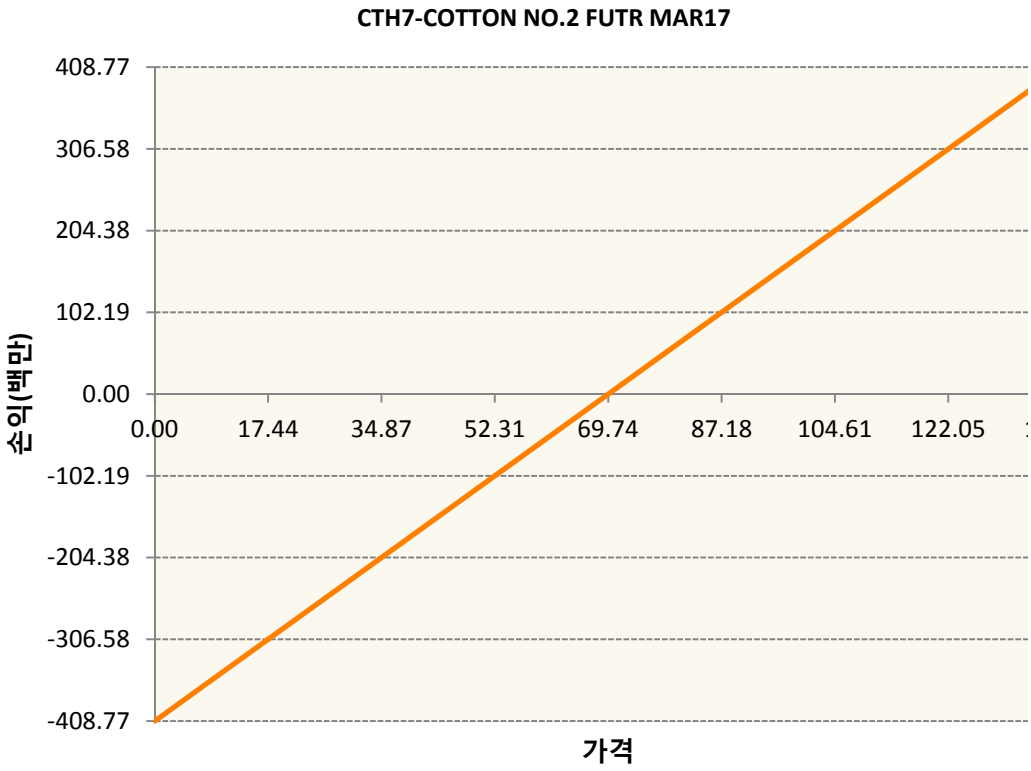
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,100	0	9,100	

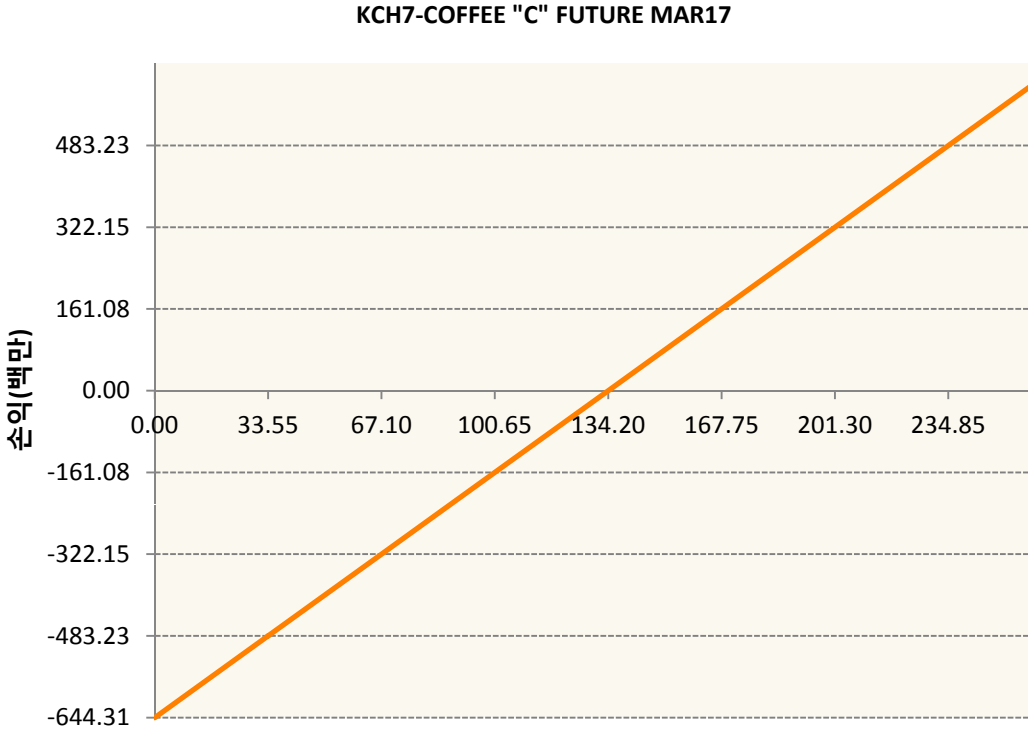
2. 만기시점의 손익구조



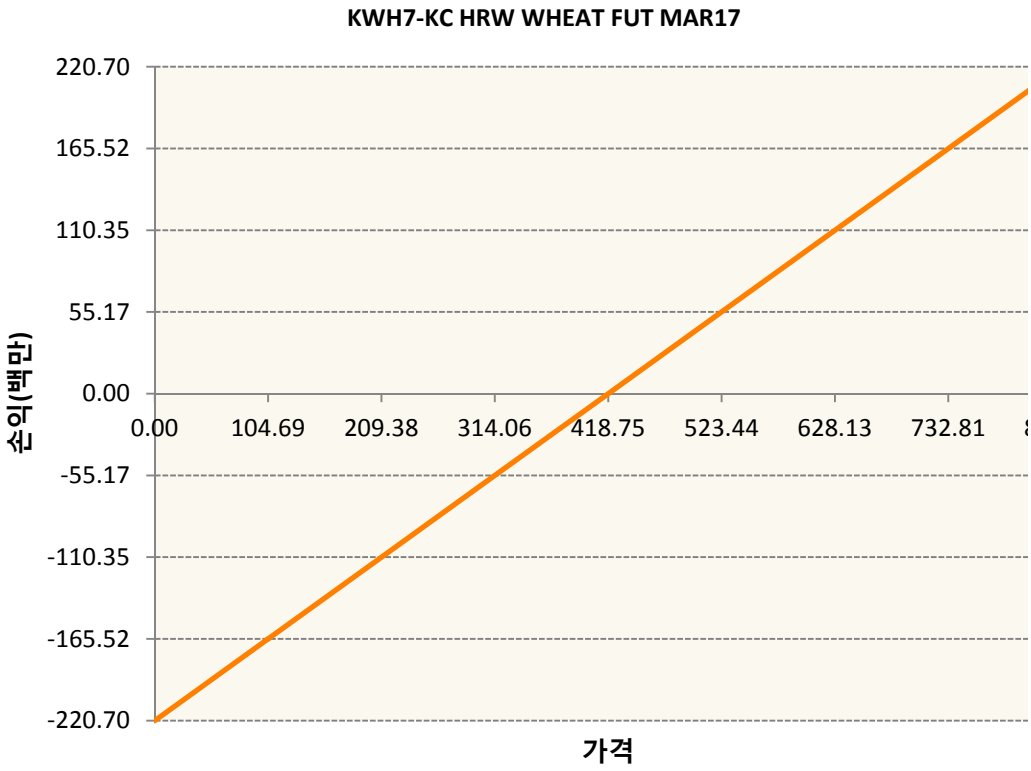


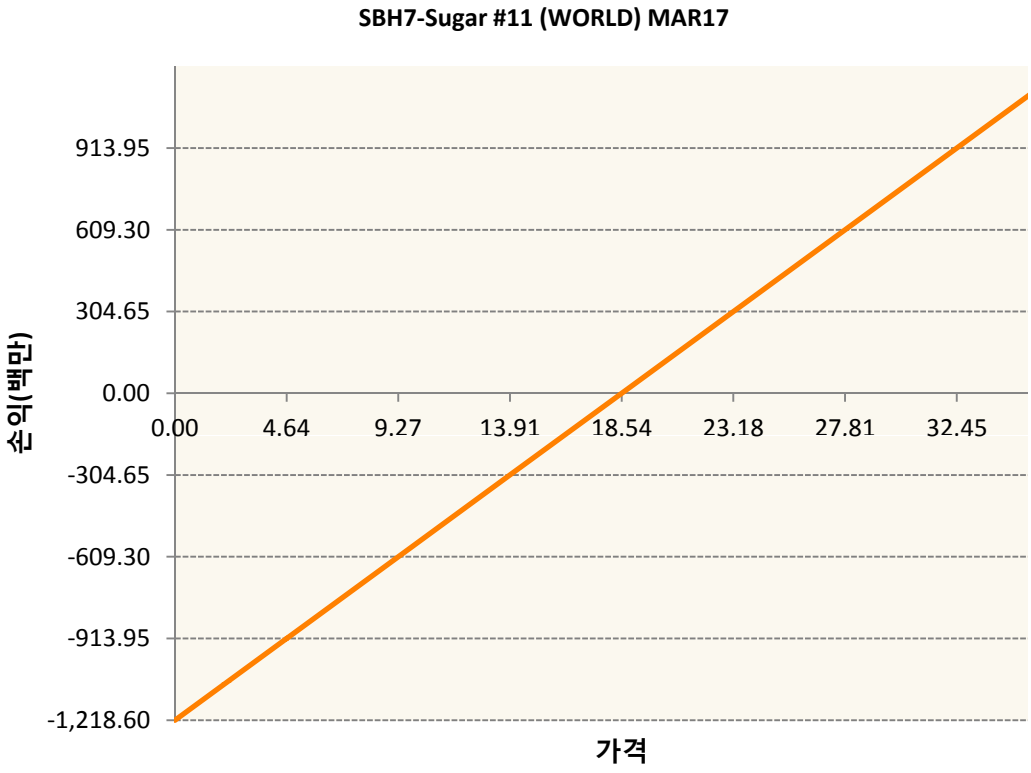

-1,560.49
-2,080.66
가격

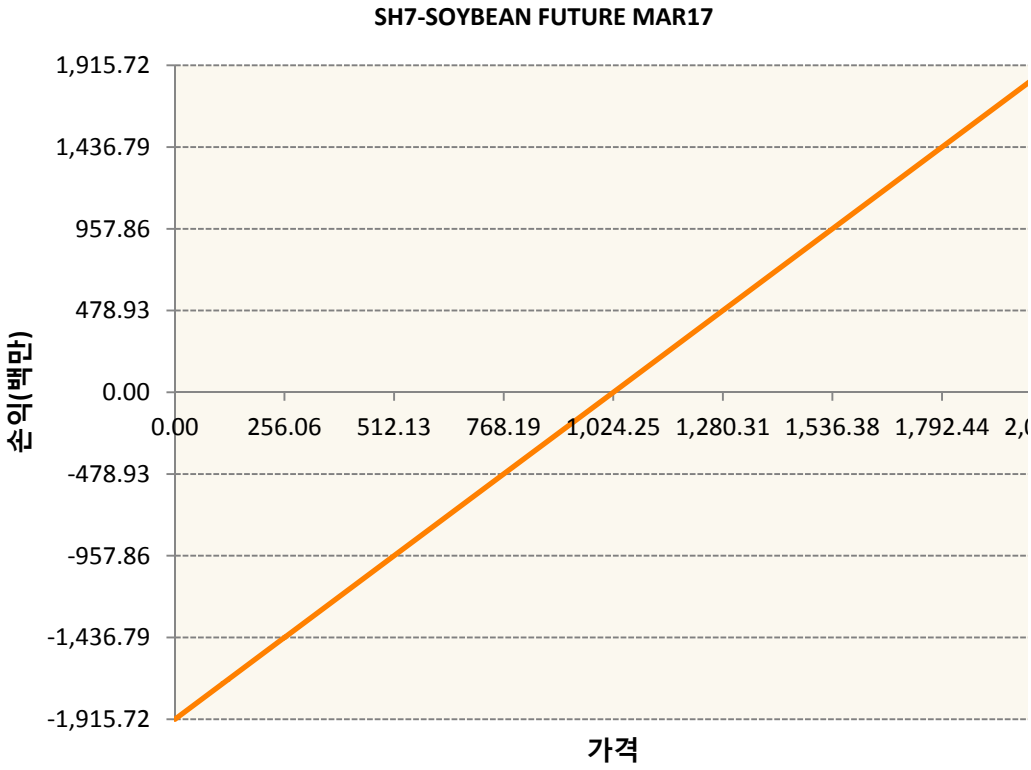

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
408.77
306.58
204.38
102.19
0.00
-102.19
-204.38
-306.58
-408.77
0.00
17.44
34.87
52.31
69.74
87.18
104.61
122.05
손익(백만)
가격

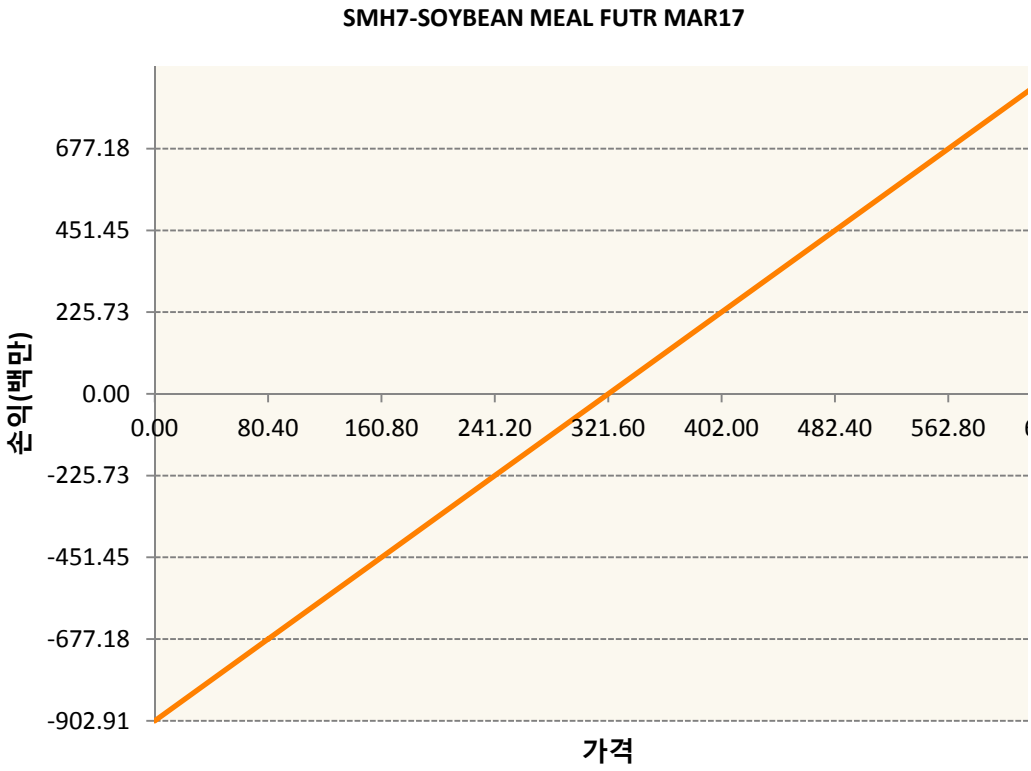

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
483.23
322.15
161.08
0.00
-161.08
-322.15
-483.23
-644.31
0.00
33.55
67.10
100.65
134.20
167.75
201.30
234.85
손익(백만)

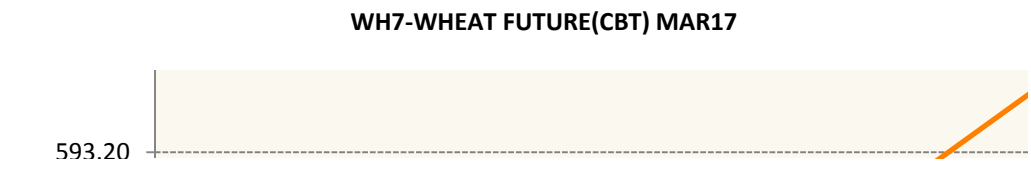
가격

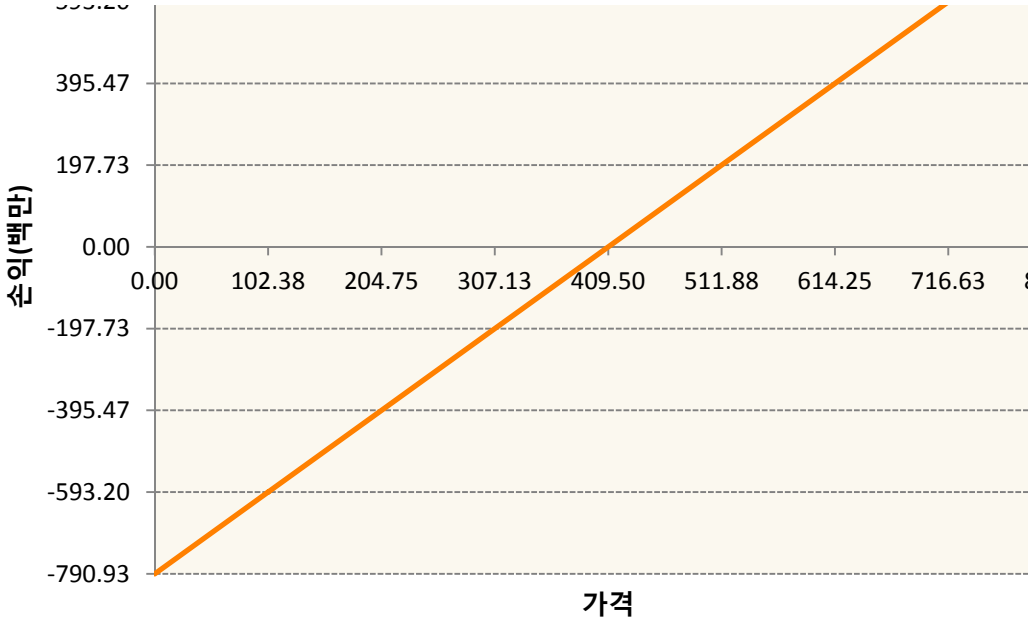

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
220.70
165.52
110.35
55.17
0.00
-55.17
-110.35
-165.52
-220.70
0.00
104.69
209.38
314.06
418.75
523.44
628.13
732.81
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
913.95
609.30
304.65
0.00
-304.65
-609.30
-913.95
-1,218.60
0.00
4.64
9.27
13.91
18.54
23.18
27.81
32.45
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,915.72
1,436.79
957.86
478.93
0.00
-478.93
-957.86
-1,436.79
-1,915.72
0.00
256.06
512.13
768.19
1,024.25
1,280.31
1,536.38
1,792.44
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
677.18
451.45
225.73
0.00
-225.73
-451.45
-677.18
-902.91
0.00
80.40
160.80
241.20
321.60
402.00
482.40
562.80
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
593.20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	166
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	52
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	97
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	153
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	72
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	877